

安信中证一带一路主题指数型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信一带一路指数
场内简称	安信一带一路
基金主代码	167503
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
报告期末基金份额总额	52,944,527.99 份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证一带一路主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	股票投资上，本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资；债券投资上，本基金将以宏观形势及利率分析为基础，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价；权证投资上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，谨慎进行权证投资；资产支持证券投资方面，综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略。
业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信一带一路指数 A	安信一带一路指数 C
下属分级基金的交易代码	167503	023110
报告期末下属分级基金的份额总额	32,373,501.89 份	20,571,026.10 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）	
	安信一带一路指数 A	安信一带一路指数 C
1. 本期已实现收益	10,199,041.81	7,545,913.27
2. 本期利润	9,699,634.20	10,661,516.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2869	0.3677
4. 期末基金资产净值	92,460,938.80	58,586,626.50
5. 期末基金份额净值	2.8561	2.8480

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信一带一路指数 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.90%	1.59%	10.52%	1.60%	0.38%	-0.01%

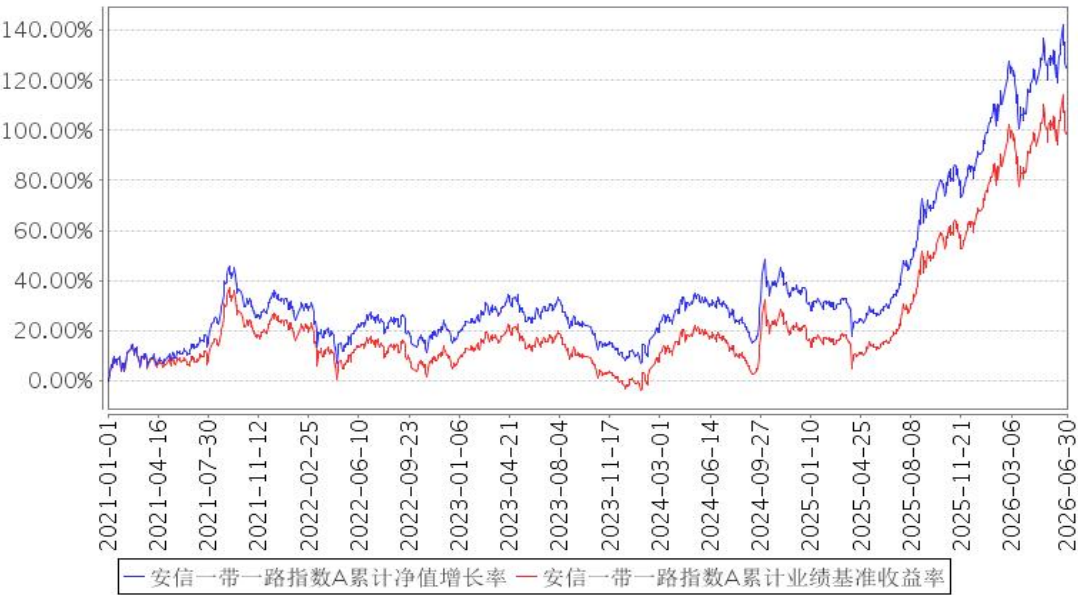
过去六个月	18.72%	1.56%	18.85%	1.59%	-0.13%	-0.03%
过去一年	69.86%	1.42%	69.28%	1.44%	0.58%	-0.02%
过去三年	76.63%	1.27%	72.78%	1.28%	3.85%	-0.01%
过去五年	97.93%	1.24%	83.23%	1.25%	14.70%	-0.01%
自基金转型 起至今	126.14%	1.24%	99.61%	1.25%	26.53%	-0.01%

安信一带一路指数 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	10.85%	1.59%	10.52%	1.60%	0.33%	-0.01%
过去六个月	18.61%	1.56%	18.85%	1.59%	-0.24%	-0.03%
过去一年	69.54%	1.42%	69.28%	1.44%	0.26%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	72.69%	1.32%	71.96%	1.34%	0.73%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信一带一路指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信一带一路指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金 2021 年 1 月 1 日由安信一带一路指数分级证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为 2021 年 1 月 1 日。

2、本基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、根据基金管理人 2025 年 1 月 3 日《关于安信中证一带一路主题指数型证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2025 年 1 月 3 日起，本基金增加 C 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱家庆	本基金的基金经理	2025 年 3 月 11 日	—	14 年	邱家庆先生，经济学硕士，历任安信基金管理有限责任公司特定资产管理部研究员，华润元大基金管理有限公司基金投资管理部基金经理助理，五矿证券有限公司总部资管量化投资部投资主办人、量化团队负责人，安信基金管理有限责任公司固定收益部投资经理、量化投资部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。现任安信中证一带一路主题指数型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第二季度，全球地缘政治风险逐步缓释，前期紧张局势显著缓和，市场避险情绪降温，风险偏好持续修复，整体资本市场迎来阶段性回暖窗口。面对逐步明朗的外部环境，一带一路指数基金坚持多行业均衡配置思路，在市场修复行情中实现净值稳步回升，兼顾进攻性与持仓稳定性。

板块表现方面，光模块及 CPO 产业链业绩兑现超预期，成为本季度核心亮点。在全球 AI 算力建设持续提速、海外云厂商资本开支加码的背景下，行业需求旺盛，头部企业订单饱满、盈利增速大幅超出市场预期，板块估值与业绩双击效应凸显。同时，受益于地缘风险降温、全球贸易与跨境投资活跃度回升，一带一路沿线基建、交通运输、高端制造等板块同步回暖，盈利修复动能持续释放。有色金属与周期板块维持稳健运行，油气板块在供需格局趋于平稳的环境下保持合理

估值水平，整体行业结构呈现多点开花态势。

配置优势方面，指数聚焦各细分领域优质龙头企业，通过多行业、多区域分散布局，有效适配市场风格切换节奏。在地缘不确定性下降、市场情绪逐步修复的阶段，均衡配置既避免了单一赛道过度集中的波动风险，又能全面把握各领域复苏机遇，在市场反弹过程中展现出良好的收益弹性与持仓韧性。

下季度展望，全球资本市场或面临宏观政策调整、行业轮动加快等多重因素影响，市场波动大概率有所加大。在此背景下，本基金将继续坚守一带一路核心投资主线，深化多行业均衡配置策略，动态优化行业结构与个股集中度，在严控组合波动的前提下，紧抓沿线经贸合作深化、基础设施互联互通带来的结构性机会。凭借板块均衡、风险分散、龙头聚焦的配置特点，更好应对市场震荡格局，力争为投资者实现风险可控下的稳健长期收益。

本基金跟踪中证一带一路主题指数，该指数从基础建设、交通运输等五大产业选取样本股。本基金秉承指数基金投资策略，通过完全复制法构建股票投资组合，依据指数成份股及其权重变动进行调整。同时，在风险可控前提下，谨慎参与股指期货投资，债券投资基于宏观形势及利率分析，权证投资综合多因素合理定价，资产支持证券投资运用多种策略。基金严格遵守风险和合规管理流程，力求控制跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信一带一路指数 A 基金份额净值为 2.8561 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.90%；安信一带一路指数 C 基金份额净值为 2.8480 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.85%；同期业绩比较基准收益率为 10.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	142,976,541.58	91.72
	其中：股票	142,976,541.58	91.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,354,289.56	2.79
	其中：债券	4,354,289.56	2.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,732,264.66	3.68
8	其他资产	2,813,204.61	1.80
9	合计	155,876,300.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,065,868.26	11.30
C	制造业	100,449,549.40	66.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,045,993.08	0.69
E	建筑业	10,532,902.60	6.97
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,903,350.14	7.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,875,923.85	1.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,873,587.33	94.59

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,997.82	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,956.43	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	102,954.25	0.07

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600176	中国巨石	75,227	5,482,543.76	3.63
2	600522	中天科技	84,346	5,118,115.28	3.39
3	300502	新易盛	7,920	4,807,440.00	3.18
4	600487	亨通光电	43,767	4,785,483.78	3.17
5	300308	中际旭创	3,600	4,572,000.00	3.03
6	603993	洛阳钼业	247,500	4,343,625.00	2.88
7	300394	天孚通信	13,774	4,169,114.32	2.76
8	600150	中国船舶	119,962	4,053,515.98	2.68
9	600309	万华化学	58,800	4,022,508.00	2.66
10	002281	光迅科技	15,100	3,879,794.00	2.57

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001248	华润新能源	7,513	75,956.43	0.05
2	001399	惠科股份	954	26,997.82	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,354,289.56	2.88
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,354,289.56	2.88

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	28,000	2,835,351.34	1.88
2	102310	国债 2513	15,000	1,518,938.22	1.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	161,411.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,651,793.32
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,813,204.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001248	华润新能源	75,956.43	0.05	新股未上市
2	001399	惠科股份	25,012.46	0.02	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信一带一路指数 A	安信一带一路指数 C
报告期期初基金份额总额	34,640,423.21	39,635,723.72
报告期期间基金总申购份额	3,247,644.62	41,004,573.63
减：报告期期间基金总赎回份额	5,514,565.94	60,069,271.25
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	32,373,501.89	20,571,026.10

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信中证一带一路主题指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信中证一带一路主题指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信中证一带一路主题指数型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2026 年 7 月 20 日